



**FT-LIQU FRANKLIN TEMPLETON DEUDA CORTO PLAZO, S.A. DE C.V. FONDO DE INVERSION EN INSTRUMENTOS DE DEUDA  
CARTERA DE VALORES AL 29 septiembre, 2017**

Tipo Valor	Emisora	Serie	Calif. / Bursatilidad	Cant. Títulos	Valor Razonable	Participación Porcentual
<b>TITULOS PARA NEGOCIAR</b>						
<b>INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>						
<b>VALORES GUBERNAMENTALES</b>						
IQ	BPAG91	180816	mxAAA	2,800,000	282,335,107.60	12.99
IQ	BPAG91	181018	mxAAA	1,350,000	136,826,895.60	6.30
IQ	BPAG91	181220	mxAAA	2,000,000	200,238,634.00	9.22
IQ	BPAG91	190417	mxAAA	1,500,000	151,959,249.00	6.99
IQ	BPAG91	190822	mxAAA	1,000,000	100,538,838.00	4.63
IQ	BPAG91	191219	mxAAA	1,300,000	129,935,302.90	5.98
LD	BONDESD	171005	mxAAA	150,000	15,073,205.55	0.69
LD	BONDESD	180419	mxAAA	150,000	15,066,910.65	0.69
LD	BONDESD	180614	mxAAA	660,968	66,382,903.96	3.06
LD	BONDESD	180816	mxAAA	690,000	69,193,969.35	3.18
LD	BONDESD	180927	mxAAA	847,591	84,753,491.49	3.90
LD	BONDESD	181213	mxAAA	1,370,000	137,125,623.52	6.31
LD	BONDESD	190627	mxAAA	709,685	70,961,682.77	3.27
LD	BONDESD	190808	mxAAA	530,000	53,125,122.40	2.45
<b>TOTAL INVERSIÓN EN TÍTULOS DE DEUDA</b>					1,513,516,936.79	69.66
<b>TOTAL TÍTULOS PARA NEGOCIAR</b>					1,513,516,936.79	69.66
<b>OPERACIONES DE REPORTE</b>						
<b>REPORTADO</b>						
IQ	BPAG91	180201	mxAAA	3,318,604	335,730,178.15	15.45
IS	BPA182	180412	mxAAA	3,132,667	323,480,535.62	14.89
<b>TOTAL OPERACIONES DE REPORTE</b>					659,210,713.77	30.34
<b>TOTAL DE INVERSION EN VALORES</b>					2,172,727,650.56	100.00

**CLASIFICACIÓN  
CORTO PLAZO**

**CALIFICACIÓN**  
AAAf/S2(mex)

**VaR Promedio**  
0.049%

**Límite de VaR**  
0.100%

Método Histórico 1 días con un nivel de confianza al 95% con 500 observaciones.

HUGO PETRICIOLI CASTELLON